

AMEX-MD**AAA/3F****SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA****DE CORTO PLAZO, EN FUNCION DE LA DURACION DE LOS ACTIVOS OBJETO DE
INVERSION, ESTIPULADOS EN SU ESTRATEGIA**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,084	5.870%
90	CBPF	48	Aaa.mx	1,530	1.268%
90	GDFCB	10	mxAAA	1,423	1.179%
BI	CETES	120823	mxA-1+	4,856	4.023%
BI	CETES	120920	mxA-1+	1,935	1.603%
				16,828	13.943%
VALORES PRIVADOS					
91	ARCA	09-4	mxAAA	4,096	3.394%
91	KIMBER	09-3	mxAAA	2,041	1.691%
91	NRF	10-2	mxAAA	2,012	1.667%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	2,004	1.660%
91	HSCCB	06	mxBB+	1,498	1.241%
91	CICB	08	mxCCC	1,288	1.067%
91	VWLEASE	07	mxAAA	1,000	0.828%
91	VWLEASE	11	mxAAA	1,003	0.831%
91	DAIMLER	11	mxAAA	1,002	0.830%
91	GMACHIP	07	mxCCC	837	0.694%
91	METROCB	03-3	mxCCC	81	0.067%
94	NAFIN	10	AAA(mex)	743	0.616%
95	PEMEX	10-3	mxAAA	2,015	1.670%
95	CFECB	05	mxAAA	1,865	1.545%
95	CFECB	10	Aaa.mx	792	0.657%
D8	KEXIM	1-08	A	3,987	3.303%
JI	CII	1-11		1,001	0.829%
				27,265	22.590%
REPORTOS					
LD	BONDES	180328	mxAAA	76,603	63.467%
				76,603	63.467%
TOTAL CARTERA				120,696	100.000%
ACTIVO NETO				120,548	
VAR ESTABLECIDO \$				72	0.06%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				1	0.00%
Cartera al:			30/Dic/2011		

Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.